

Paris, le 25 septembre 2014

## Prix 2014 du meilleur mémoire de master de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative

**Laurent Mignon, directeur général de Natixis, et Michel Crouhy, président de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative, ont remis le prix 2014 du meilleur mémoire de master à Johannes Heinrich, Joël Bun et Salmane Lahdachi.**

### Le prix du meilleur mémoire de master

Ce prix récompense chaque année des travaux d'une qualité exceptionnelle sur des sujets complexes d'actualité pour les banques, les assureurs et les sociétés de gestion. Ces travaux nécessitent le recours aux techniques de la finance quantitative les plus évoluées.

« Comme chaque année, le comité scientifique de la Fondation a été impressionné par la qualité des mémoires soumis pour ce prix sur des thèmes très variés. Comme l'année dernière nous constatons un net déplacement de la recherche en finance quantitative vers des problématiques qui touchent à la réglementation et à la gestion des risques », note Michel Crouhy.

### Les lauréats

Le comité scientifique de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative a sélectionné cette année trois lauréats parmi les 12 mémoires qui ont été soumis pour le Prix du meilleur mémoire de master :

**Johannes Heinrich**, du MSc in Mathematics and Finance of Imperial College:  
Reinforcement Learning for Algorithmic trading ;

**Joël Bun**, du Master 2 Modélisation Aléatoire, Université Paris Diderot:  
Out-of-Sample Risk Optimization Using Random Matrix Theory  
réalisé chez Capital Fund Management ;

**Salmane Lahdachi**, du Master M2 Probabilités & Finance de l'Université Pierre & Marie Curie–Paris VI:  
Environnement Multi-Courbes et Marges de Basis Stochastiques,  
réalisé chez Crédit Agricole – CIB.

**La Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative a pour objet le financement des recherches et manifestations dans le domaine de la finance quantitative (finance des marchés, gestion des risques, économétrie, finance statistique, valorisation des produits dérivés complexes). Elle finance des bourses de thèse de doctorat et des travaux de recherche universitaire sur des thèmes en prise directe avec les préoccupations actuelles des institutions financières. Elle co-organise des conférences avec des institutions universitaires de premier plan et récompense des travaux de recherche réalisés dans le cadre de thèses et de mémoires de fin d'études.**

### Contact presse :

Barbara Durand  
Barbara.durand@natixis.com  
+33 1 58 19 47 41

 Suivez-nous sur Twitter! @Natixis\_com